
서울 영등포구 국제금융로6길 38 화재보험협회빌딩 / TEL : 3215-1437 / FAX : 3215-1444 / 담당자 : 홍가람

문서번호 : KISP-0021-20240613-1호

발송일자 : 2024. 06. 13

수 신 : 수신처 참조

제 목 : 실시간 채권지수 바스켓 변경 안내의 건

1. 귀사의 무궁한 발전을 기원합니다.
2. 당사에서 발표하는 KIS 10Y KTB Index 및 KIS 10Y KTB Leverage Index의 바스켓 변경 내역을 별첨과 같이 안내하여 드리오니 업무에 참고하시기 바랍니다.

별 첨 : 실시간 채권지수 바스켓 변경내역 1부. 끝.

키스자산평가(주) 펀드평가실

별첨 : 실시간 채권지수 바스켓 변경내역

1. 대상지수명 : KIS 10Y KTB Index

1) 변경일자: 2024년 6월 18일 (화)

2) 종목 편출입 내역

- 편출입 내역 없음.

3) 변경 후 바스켓 내역

구분	섹터	종목코드	채권명	발행일	만기일
1	국고채	KR103502GCC8	국고04250-3212(국고22-14)	2022-12-10	2032-12-10
2	국고채	KR103502GD64	국고03250-3306(국고23-5)	2023-06-10	2033-06-10
3	국고채	KR103502GDC6	국고04125-3312(국고23-11)	2023-12-10	2033-12-10

4) 바스켓 변경 후 추정 보조지수

구분	변경전(6/17)	변경후(6/18)	증감
평균 Duration (년)	7.56	7.56	-0.003
평균 Coupon (%)	3.88	3.88	-0

2. 대상지수명 : KIS 10Y KTB Leverage Index

1) 변경일자: 2024년 6월 18일 (화)

2) 종목 편출입 내역

구분	종류	종목코드	종목명	발행일	만기일
편출	선물	KR4167V60003	신10년국채 F 202406	2023-12-20	2024-06-18
편입	선물	KR4167V90000	신10년국채 F 202409	2024-03-20	2024-09-13

3) 변경 후 바스켓 내역

구분	종류	종목코드	종목명	발행일	만기일
1	국고채	KR103502GCC8	국고04250-3212(국고22-14)	2022-12-10	2032-12-10
2	국고채	KR103502GD64	국고03250-3306(국고23-5)	2023-06-10	2033-06-10
3	국고채	KR103502GDC6	국고04125-3312(국고23-11)	2023-12-10	2033-12-10
4	선물	KR4167V90000	신10년국채 F 202409	2024-03-20	2024-09-13

4) 바스켓 변경 후 추정 보조지수

구분	변경전(6/17)	변경후(6/18)	증감
평균 Duration (년)	15.54	15.54	-0.001

끝.